

**ГАЗПРОМБАНК**

**Параметры выпуска биржевых облигаций
Банка ГПБ (АО) с дополнительным доходом
серии 002P-03-IMOEX_CALL_SPREAD**

Эмитент	«Газпромбанк» (Акционерное общество)
Кредитный рейтинг эмитента	Ba2 (Moody's)/ BB+ (S&P)/ BB+ (Fitch)/ AA(RU) (АКРА) / ruAA+ (Эксперт РА)
Идентификационный номер Программы облигаций	400354B002P02E от 16.04.2018
Идентификационный номер выпуска облигаций	4B020300354B002P
Серия облигаций	002P-03-IMOEX_CALL_SPREAD
Кредитный рейтинг бумаги	отсутствует
Номинальная стоимость	1 000 рублей
Объем выпуска	1 000 000 000 рублей
Срок обращения	547 дней
Оферта	отсутствует
Купонный период	547 дней
Гарантированный доход	0,01% годовых
Дополнительный доход	Предусматривается выплата дополнительного дохода в соответствии с формулой, приведенной в приложении
Способ размещения	Букбилдинг
Сбор предварительных заявок	Период сбора предварительных заявок: с 12.12.2018 по 26.12.2018 Дата активации (удовлетворения) предварительных заявок: 27.12.2018 (равна дате начала размещения) Сбор предварительных заявок происходит на Бирже в режиме «Размещение: Адресные заявки»
Дата начала размещения и метод проведения расчетов	27.12.2018 ПАО Московская Биржа - режим «Размещение: Адресные заявки»
Регламент размещения на Бирже в дату размещения	Основная сессия: - период сбора основных заявок: 10:00 – 16:00 - период удовлетворения основных заявок: 16:30 – 17:29 Дополнительная сессия: - период сбора и удовлетворения основных заявок: с момента окончания перерыва на клиринговую сессию НКЦ до 18:30
Цена размещения	100% от номинала
Листинг	3 уровень
Организатор	«Газпромбанк» (Акционерное общество)
Агент по размещению	«Газпромбанк» (Акционерное общество)
Депозитарий облигаций	НКО АО НРД



Порядок определения и условия выплаты дополнительного дохода по биржевым облигациям Банка ГПБ (АО) серии 002P-03-IMOEX_CALL_SPREAD

1. В случае если не выполняется Условие невыплаты дополнительного дохода (как оно определено в пп. 3. ниже):

$$\text{ДД (в \%)} = \min[\max\{(\text{БА}_{\text{фин}} / \text{БА}_{\text{нач}} - 1); 0\}; (\text{БА}_{\text{бар}} / \text{БА}_{\text{нач}} - 1)] * K * 100\%$$

где:

ДД (%) – размер дополнительного дохода, в процентах;

max – функция максимального значения указанных переменных;

min – функция минимального значения указанных переменных;

БА_{нач} – значение Базового актива на дату размещения Биржевых облигаций, в пунктах;

БА_{фин} – значение Базового актива на Дату определения значения Базового актива, в пунктах;

БА_{бар} – Барьерное значение Базового актива, равное **БА_{нач}*1,2**, в пунктах;

K – коэффициент участия, равный **1**.

Дополнительный доход в процентах рассчитывается с точностью до пятого знака после запятой (округление пятого знака после запятой производится по правилам математического округления: в случае, если шестой знак после запятой больше или равен 5, пятый знак после запятой увеличивается на единицу, в случае, если шестой знак после запятой меньше 5, пятый знак после запятой не изменяется).

В случае если выполняется Условие невыплаты дополнительного дохода, как оно определено в пп. 3 ниже, либо в случае досрочного погашения Биржевых облигаций:

$$\text{ДД (\%)} = 0,00\%.$$

2. **Базовый актив** – значение «Индекса МосБиржи» (ISIN: RU000A0JP7K5), рассчитываемое Биржей в соответствии с Методикой расчетов Индексов Московской Биржи, публикуемое на странице в сети Интернет <https://www.moex.com/ru/index/IMOEX/archive> (поле «Закрытие») (или иная страница в сети Интернет, используемая Московской биржей для раскрытия данной информации).

Дата определения значения Базового актива:

А) 3-ий рабочий день, предшествующий дате погашения Биржевых облигаций (в случае, если в указанную дату значение Базового актива может быть определено в соответствии с положениями настоящего пп.2 выше).

Б) Если на Дату определения значения Базового актива, указанную в п. (А), значение Базового актива не опубликовано на странице в сети Интернет, на которой публикуется такое значение в соответствии с положениями настоящего пп.2 выше, или указанная страница в сети Интернет недоступна, или по любым иным причинам невозможно получить информацию о таком значении на указанной странице в сети Интернет, то Датой определения значения Базового актива является последовательно 4-ый, 5-ый, 6-ой, ..., (n-1)-ый, n-ый рабочий день (заканчивая датой начала размещения), предшествующий дате погашения Биржевых облигаций (т.е. последовательно проводится определение значения Базового актива в указанные даты до тех пор, пока значение Базового актива не будет определено).

В случае если значение Базового актива не может быть определено в указанные даты в соответствии с положениями настоящего пп.2, то считается, что для расчета



дополнительного дохода выполняется Условие невыплаты дополнительного дохода, как оно определено ниже.

3. **Условие невыплаты дополнительного дохода** – значение Базового актива в Дату определения значения Базового актива (**БА_{фин}**) не может быть определено в соответствии с положениями пп.2 выше.

4. Порядок расчета суммы дополнительного дохода, подлежащего выплате на одну Биржевую облигацию (в рублях):

$$\text{ДД (руб)} = \text{ДД (\%)} * N$$

где:

ДД (%) – размер дополнительного дохода, рассчитанный в порядке, указанном выше, в процентах;

N – номинальная стоимость одной Биржевой облигации, равная 1 000 рублей.

Дополнительный доход в рублях Российской Федерации, подлежащий выплате на одну Биржевую облигацию, рассчитывается с точностью до второго знака после запятой (округление цифр при расчете дополнительного дохода в валюте номинала производится по правилам математического округления. При этом под правилом математического округления следует понимать метод округления, при котором в случае, если третий знак после запятой больше или равен 5, второй знак после запятой увеличивается на единицу, в случае, если третий знак после запятой меньше 5, второй знак после запятой не изменяется).

НАСТОЯЩЕЕ СООБЩЕНИЕ И ДОКУМЕНТЫ, ПРЕДСТАВЛЕННЫЕ ВАШЕМУ ВНИМАНИЮ, НЕ ЯВЛЯЮТСЯ ПРЕДЛОЖЕНИЕМ О ПРОДАЖЕ КАКИХ-ЛИБО ЦЕННЫХ БУМАГ И НЕ ПРЕДНАЗНАЧЕНЫ ДЛЯ ОЗНАКОМЛЕНИЯ ИЛИ ДОСТУПА ЛИЦАМ, НАХОДЯЩИМСЯ В ЕВРОПЕЙСКОМ СОЮЗЕ, СОЕДИНЕННЫХ ШТАТАХ АМЕРИКИ, АВСТРАЛИИ, КАНАДЕ ИЛИ ЯПОНИИ.

«Газпромбанк» (Акционерное общество) (далее – Эмитент) настоящим не делает предложения о продаже каких-либо ценных бумаг и не осуществляет действий, направленных на получение предложения о покупке каких-либо ценных бумаг в отношении любых лиц, находящихся в любой юрисдикции. Настоящее сообщение и документы, представленные Вашему вниманию, не могут быть использованы для или в связи с подготовкой любого сообщения в любых юрисдикциях или при любых обстоятельствах, в/при которых такое подготовленное сообщение будет считаться недопустимым или незаконным. Эмитент требует от каждого лица, которое получает доступ к настоящему сообщению и документам, изучить и соблюдать такие ограничения. Документы, представленные для Вашего ознакомления, носят исключительно информационный характер и не являются рекламой или предложением о продаже каких-либо ценных бумаг в любой стране.

ВЛАДЕНИЕ БИРЖЕВЫМИ ОБЛИГАЦИЯМИ ИЛИ ДРУГИМИ ФИНАНСОВЫМИ ИНСТРУМЕНТАМИ ВСЕГДА СВЯЗАНО С РИСКАМИ. Настоящее сообщение носит исключительно информационный характер и содержит очень ограниченную информацию об инвестировании в ценные бумаги Эмитента. Такому инвестированию должно предшествовать взвешенное решение, основанное, среди прочего, на тщательном анализе Эмитента, его аффилированных лиц, операций, финансового состояния, продаж и доходов, состояния российской экономики в целом и других риск-факторов

Перед заключением любых сделок, связанных с инвестированием в биржевые облигации Эмитента, Клиент должен оценить экономические риски и выгоды, а также юридические и налоговые последствия таких сделок, не полагаясь на мнение работников Эмитента и/или его дочерних и аффилированных структур.

При приобретении биржевых облигаций с дополнительным доходом, размещаемых в рамках Программы биржевых облигаций серии 002Р (далее – Индексные облигации) помимо общих рисков, связанных с операциями на рынке ценных бумаг, существуют следующие риски, которые могут повлечь существенные финансовые потери:

- Политические, экономические, валютные и кредитные риски стран местонахождения Эмитента Индексных облигаций, а также страны местонахождения эмитентов ценных бумаг, составляющих инвестиционную корзину или базовый актив Индексной облигации (далее – Базовый актив), лежащих в ее основе, от изменения цены которых зависит величина дополнительного дохода, выплачиваемого в дату погашения Индексной облигации, в дату выплаты купона по Индексной облигации или в иную дату, определенную условиями выпуска такой облигации.

- Кредитные риски Эмитента Индексной облигации, а также кредитный риск эмитентов ценных бумаг, составляющих Базовый актив индексной облигации.

- Риски ликвидности Индексной облигации в связи с остановкой или нарушением торгов на вторичном рынке Индексной облигации, либо торгов ценными бумагами, составляющими Базовый актив Индексной облигации, либо отсутствием встречных заявок на покупку/продажу Индексных облигаций.



– Риски изменения условий существования Базовых активов: условия существования Базовых активов Индексных облигаций могут изменяться в связи с наступлением существенных событий, таких как остановка или нарушение торгов на Базовый актив Индексной облигации, замена Базового актива Индексной облигации и/или досрочное погашение Индексной облигации по причинам, связанным с реорганизацией (включая слияние, поглощение, дробление акций, ликвидацию и т.п.) одного или нескольких эмитентов, чьи ценные бумаги входят в Базовый актив Индексной облигации.

– Риски возникновения затруднений в оценке справедливой стоимости Базового актива Индексной облигации и Индексной облигации по причинам, связанным с остановкой или нарушением торгов на Базовый актив Индексной облигации, либо с реорганизацией (включая слияние, поглощение, дробление акций, ликвидацию и т.п.) одного или нескольких эмитентов, чьи ценные бумаги входят в состав Базового актива Индексной облигации.

– Валютные риски при расчете налога: согласно законодательству Российской Федерации доходы и расходы в иностранных валютах оцениваются в рублях Российской Федерации. Проводя операции с ценными бумагами, номинированными в иностранных валютах, резидент Российской Федерации принимает на себя риск изменения эффективной ставки налогообложения в зависимости от колебания курсов валют.

– Риски, связанные с неопределенностью налоговых последствий инвестиций в Индексные облигации.

– Риски при продаже Индексных облигаций до наступления срока погашения, поскольку обязательство возврата (полного или частичного) Эмитентом первоначально инвестированного капитала действует только на дату погашения Индексной облигации.

– Риски инвестирования в Индексные облигации, вызванные изменением рыночной цены Базового актива Индексной облигации и, как следствие, неполучение дополнительного дохода.

– Риски, связанные с изменением сроков поставки Индексных облигаций по независящим от Эмитента и/или его дочерних и аффилированных структур причинам, в том числе связанные с неисполнением и/или несвоевременным исполнением третьим лицом (контрагентом) обязательств по сделке, заключенной по поручению инвестора.

– И иные риски.